

eRed Folder : [Add](#) [View](#)[Previous Doc](#) [Next Doc](#) [Go to Doc#](#)  
[First Hit](#)**JPDB General Collection**

Search Result 1 of 1

Date: JPNB

Rev. 2/1, 2001

PUB-NO: JP62001117974A

INVENT-IDENTIFIER: JP 2001117974 A

TITLE: METHOD AND SYSTEM FOR INFERRING COMPLICATED SECURITIES, USING LITTLE DIFFERENT DECISION-THEORETIC STREAM AND PORTFOLIO CONSTITUTING METHOD

PUB-DATE: April 27, 2001

## INVENTOR INFORMATION:

NAME: [SUBRAMANIAN](#)

CORPORATE

NAME: [TOMARIYU](#)NAME: [FASUNOYA](#)NAME: [TANAKAHIROCO](#)NAME: [AKABEISUKE](#), [PANADEEJISU](#)

## ASSIGNEE INFORMATION:

NAME: [COLUMBIA CITY IN THE CITY OF NEW YORK](#)

CORPORATE

ADDRESS: 60 COLUMBIA LANE IN THE CITY OF NEW YORK

APPL-NO: JP11288401

APPL-DATE: October 7, 1999

INT-CL (IPC): G06F 17/00

## ABSTRACT:

PROBLEM TO BE SOLVED: To provide a method and a system for inferring complicated securities and a portfolio constituting method.

SOLUTION: The method for inferring complicated securities is provided with a step for providing at least one multi-variation function to be integrated expressing an inferred value at least in one part of the complicated securities in the case of integration within the range of integration, a step for calculating an integrated value at a point inside the range of integration provided from a little different decision-theoretic stream with a computer and a step for performing one of purchasing, owning and selling of the complicated securities on the basis of an entire value including the estimated value, and the portfolio constituting method is provided with a step for calculating a list of instant loss function values at the point provided from the little different decision-theoretic stream inside the area of stochastic market elements with the computer, a step for determining the cumulative distribution function of the said function value, a step for determining a dangerous value as one of function values corresponding to the designated level of credit, and a step for constituting the portfolio corresponding to the comparison of the dangerous value and the designated target value.

COPYRIGHT: (C)2001,JPNB

[Previous Doc](#) [Next Doc](#) [Go to Doc#](#)

(1)日本特許庁 (J P)

(2) 公開特許公報 (A)

(3)特許出願公開番号

特開2001-1117974

(P2001-1117974A)

(4)公開日 平成13年4月27日 (2001. 4. 27)

(5)InLCL  
G 06 F 17/00

機械記号

P [  
G 06 F 17/00]

5-20-1 (参考)  
Q 5 B 0 4 9  
Z

審査請求 曹 漢求書の表38 O. L. (全 10 頁)

(21)出願登録番号 11-286401

(74)代理人 100059256

(22)出願日 平成11年10月7日 (1999. 10. 7)

弁理士 松村 繁秀 (外2名)

最終頁に続く

(54)【発明の名称】 少額賠償決定的列を提供する複雑な賠償の推定方法及びシステムと、ポートフォリオ構成

(55)【要約】

【課題】 複雑な賠償の推定方法及びシステムと、ポートフォリオ構成方法とを提供する。

【解決手段】 複雑な賠償の推定方法は、積分の範囲で積分した場合、前記複雑な賠償の少なくとも一部の推定値を表す少なくとも一つの多変量複数分離面を得るステップと、少額賠償決定的列から構成された前記複雑な範囲内の点における積分値をコンピュータによつて計算するステップと、前記推定値を含む全体像に基いて前記複雑な範囲を、個人、保有および売却の割合11を用いて行うステップとを具え、ポートフォリオ構成方法は、確率的扔擲器の結果に対する少額賠償決定的列から得られた点における各段の潜在的損失閾値を、コンピュータによって計算するステップと、前記複雑な範囲分佈割合を決定するステップと、前記複雑な範囲を構成された當用のレベルに対応する前記閾値割合11にして決定するステップと、前記ポートフォリオを、計算した値と推定された目標値との比較に応じて調整するステップとを具える。

